

图书基本信息

书名：<<衍生性商品与ISDA合约法务控管实务手册>>

13位ISBN编号：9789867263506

10位ISBN编号：9867263502

出版时间：2005

出版时间：宝来证券(香港)有限公司

作者：简坚训

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

## <<衍生性商品与ISDA合约法务控管实>>

### 内容概要

不斷推陳出新之金融商品，變化金融市場參與者之投資組合、撼動金融機構之業務版圖、激盪多元化風險控管思考邏輯、考驗立法者規範技術。

衍生性商品法務難度不在於靜態法規架構及既定法律邏輯，係在多重動態非法律因子包含衍生性商品性質、交易型態、市場需求、風險控管規範進程等。

接觸衍生性商品法務之初，讓作者感覺總是捉摸五里霧中，直至嘗試放棄法務窠臼，先由客戶及初學者地位認識商品，取得業務人之溝通語言，再回過頭反覆交叉比對分析，終於得到稍微精確之視野。

作者目前於證券商執掌衍生性商品法務風險控管，希望藉由本書讓衍生性商品市場相關參與者，能對於證券商衍生性商品基本法務架構及操作便於理解，進而增進法律風險控管之認識。

本書涵蓋三大架構包含法源、ISDA合約法律實務、及個別衍生性商品法律操作，逐步闡述證券商衍生性商品法律實務。

方法上擬以衍生性商品法源說明為基底，劃出他律性風險控管範圍；再以ISDA合約架構為視角，配合部分個別商品細節，進而勾勒出目前證券商衍生性商品之法律實務主要輪廓；最後導出自律性風險控管之重要性及未來應注意之面向。

參考文獻背景方面，包含有關衍生性商品及其風險控管書籍、相關案例及判決、ISDA網站及其公佈之相關文件、另含個人從事衍生商品與主管機關、交易對手、相關實務經驗。

藉由目前衍生性商品法務控管說明、分析並提具淺見及建議供先進參酌，以便於業界有此需求或興趣者基本之認識或進一步研究。

金融商品由現貨、期貨、進展至目前熱門之衍生性商品（Derivatives）。

所謂衍生性商品係指「其價值由資產、利率、匯率、指數或其他利益等商品所衍生之遠期契約、選擇權契約、期貨契約、槓桿保證金契約、交換契約，及上述商品組合而成之複合式契約等」。

透過縝密的財務工程，衍生性商品同時兼具投資及避險（hedge）功能，性質上同時為商品亦為操作工具，提供投資人在市場上有多樣化之選擇，使得衍生性商品交易逐漸熱絡。

但因衍生性商品操作專業性、市場易變動性、與損益高槓桿性，導致交易風險相對增加，影響交易安全甚鉅。

因此，不論主管機關制定「他律性風險控管」規範，及衍生性商品業務人或其他從事該交易主體之內部「自律性風險控管」規範，均有迫切認識之必要。

近來衍生性商品交易管理更被納入為公司治理（Corporate Governance）原則之重要部分，可見亟需高層次監控機制，不能予以輕忽。

證券商操作衍生性商品風險類型與其他商品一樣，範圍概略可區分為市場風險、信用風險、作業風險、法律風險，以上除市場風險較難掌握以外，其他部分則非無預防空間；其中法律風險之預防，法令明文規範外，ISDA合約占有亟重要之地位。

許多業界先進均明瞭操作衍生性商品與ISDA相關合約有相當密切之關係，但什麼是ISDA？

詳細內容？

ISDA與衍生性商品有何關係？

個別商品如何適用？

主導證券商衍生性商品中最重要之ISDA法律文件，ISDA合約基本架構及法律關係，其中梗概則有詳加探求之必要。

## 作者简介

簡堅訓，東吳大學比較法法學士，淡江大學國際法法學碩士。

擁有證券高級業務員、投信投顧業務員、期貨業務員、股務人員、銀行內稽內控、銀行授信、銀行信託等證照。

現任寶來金融集團法務經理。

聖約翰技術學院財務金融系兼任講師，世新大學法律研究所網路金融交易講座

著有 ISDA合約法務控管初探（《台灣期貨暨衍生性商品學刊》2003年第一期）、EC經營者的第一堂法律課 《數位科技》九十三年四月號

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>